泰信中证200指数证券投资基金

【2016】第四季度报告

基金管理人:泰信基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2017年1月20日

§1 重要提示

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据基金合同已于2017年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信中证200指数
交易代码	290010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月9日
报告期末基金份额总额	51,415,704.53份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,以实现对标的指数的有效跟踪。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金主要采用完全复制法,按照在中证200指数中的成份股的构成及其基准权重构建投票投资组合,以拟合和跟踪中证200的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	中证200指数收益率×95%＋商业银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金为指数型基金,具有较高风险和较高预期收益的特征,其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。其风险因素主要来自于市场风险和跟踪误差的风险。
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	-1,097,222.14
2.本期利润	-295,671.41
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0057
4.期末基金资产净值	52,390,827.47
5.期末基金份额净值	1.019

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

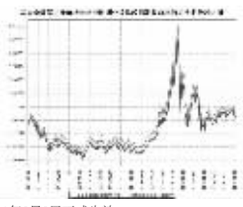
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.59%	0.73%	-0.40%	0.74%	-0.19%	-0.01%

注:本基金业绩比较基准为:中证200指数收益率×95% ＋ 商业银行活期存款利率(税后)×5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金基金合同于2011年6月9日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满,基金投资组合各项比例符合基金合同的约定:股票资产占基金资产90%-95%,投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于股票资产的90%。现金以及到期日在1年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张彦先生	本基金经理兼泰信中证基本面400指数分级基金经理	2015年1月6日	-	10年	研究生硕士,具有基金从业资格,曾任职于国金证券研究所、上海从容投资管理有限公司、万家基金管理有限公司。2011年6月加入泰信基金管理有限公司,担任高级研究员,自2011年10月至2014年5月任泰信中小盘精选基金经理助理。2012年4月至2015年1月任泰信优势增长混合基金经理助理。自2015年1月6日起同时兼任泰信中证锐联基本面400指数分级基金经理。

注:1、以上日期均是指公司公告的日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信中证200指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为,本基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(中国证监会公告[2011]18号),公司制定了《公平交易制度》,适用于所有投资品种,以及所有投资管理活动,涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各环节,从研究、投资、交易合规性监控,发现可疑交易立即报告,并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放,基金经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令,所有投资指令在集中交易室集中执行,投资交易过程公平公正,投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内,投资交易监控与价差分析未发现本基金与其他基金之间存在利益输送行为,公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内,本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易,未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况,亦无其他异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾四季度, A股在经济回暖、险资举牌、地产调控的背景下,指数冲高回落,上证综指上涨3.29%,而创业板则破位下跌8.74%,大盘蓝筹股表现好于中小盘股票。

报告期内,本基金作为被动操作的指数基金,严格执行基金合同规定的投资策略,按照规定的投资策略和方法进行投资操作,努力拟合标的指数,减小跟踪误差,报告期内跟踪误差控制在0.74%。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金单位净值为1.019元,本季度净值增长率为-0.59%,业绩比较基准增长率为-0.40%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	49,730,994.44	94.54
	其中:股票	49,730,994.44	94.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,870,311.02	5.46
8	其他资产	3,192.69	0.01
9	合计	52,604,498.15	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	404,333.28	0.77
B	采矿业	2,056,932.49	3.92
C	制造业	21,837,888.15	41.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	709,226.14	1.35
E	建筑业	1,525,384.76	2.91
F	批发和零售业	2,124,616.77	4.06
G	交通运输、仓储和邮政业	2,185,028.57	4.17
H	住宿和餐饮业	70,704.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,016,642.68	11.48
J	金融业	5,498,120.30	10.49
K	房地产业	2,898,362.36	5.53
L	租赁和商务服务业	1,496,757.16	2.84
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	739,634.34	1.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	178,921.60	0.34
R	文化、体育和娱乐业	1,476,869.05	2.82
S	综合	534,574.80	1.02
	合计	49,730,994.44	94.92

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

报告期末本基金未持有积极投资股票。

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有沪港通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002450	康得新	36,713	701,585.43	1.34
2	601009	南京银行	54,049	585,891.16	1.12
3	601939	建设银行	99,800	542,912.00	1.04
4	601099	太平洋	103,810	534,621.50	1.02
5	000783	长江证券	50,565	517,177.85	0.99
6	300070	碧水源	27,833	487,634.16	0.93
7	002142	宁波银行	29,020	482,892.80	0.92
8	000503	海虹控股	10,672	448,757.60	0.86
9	600089	特变电工	48,194	440,011.22	0.84
10	000768	中航飞机	20,504	435,915.04	0.83

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

报告期末本基金未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末本基金未投资贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

除此以外本基金投资前十名股票中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,617.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	575.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,192.69

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末基金未持有积极投资股票。

5.11.6 本报告涉及合计数相关比例的,均以合计数除以相关数据计算,而不是对不同比例进行合计。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	52,021,476.20
报告期间基金总申购份额	244,353.80
减:报告期间基金总赎回份额	850,125.47
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	51,415,704.53

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	19,037,101.26
报告期间买入/申购总份额	0.00
报告期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期末管理人持有的本基金份额	19,037,101.26
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	37.03

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信中证200指数证券投资基金设立的文件

2、《泰信中证200指数证券投资基金基金合同》

3、《泰信中证200指数证券投资基金招募说明书》

4、《泰信中证200指数证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

8.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所,供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后,投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件或复印件。

8.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)查阅上述相关文件,或拨打客户服务中心电话(400-888-5988,021-38784566),和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司
2017年1月20日

泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金

【2016】第四季度报告

基金管理人:泰信基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年1月20日

§1 重要提示

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同已于2017年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信基本面400指数分级		
场内简称	泰信400		
交易代码	162907		
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)		
基金合同生效日	2012年9月7日		
报告期末基金份额总额	57,562,567.06份		
投资目标	本基金采用指数化投资策略,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,追求对中证锐联基本面400指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金主要采用完全复制法,按照在中证锐联基本面400指数中的成份股的构成及其基准权重构建投票投资组合,以拟合和跟踪中证锐联基本面400指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。		
业绩比较基准	95%×中证锐联基本面400指数收益率＋5%×商业银行人民币活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。		
基金管理人	泰信基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金简称	泰信基本面400A	泰信基本面400B	泰信基本面400
下属分级场内简称	泰信400A	泰信400B	泰信400
下属分级基金交易代码	150094	150095	162907
下属分级基金报告期末基金份额总额	6,543,401.00份	6,543,401.00份	44,465,765.05份
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	高风险、高预期收益。	较高风险、较高预期收益。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	-298,895.17
2.本期利润	377,266.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0063
4.期末基金资产净值	43,949,667.13
5.期末基金份额净值	0.764

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人申购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

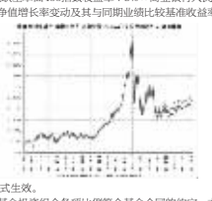
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.79%	0.79%	1.67%	0.79%	-0.88%	0.00%

注:本基金业绩比较基准为:95%×中证锐联基本面400指数收益率＋5%×商业银行人民币活期存款利率(税后)

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金基金合同于2012年9月7日正式生效。

2、本基金的建仓期为六个月。建仓期满,基金投资组合各项比例符合基金合同的约定。本基金投资于中证锐联基本面400指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%;现金以及到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张彦先生	本基金经理兼泰信中证200指数基金经理	2015年1月6日	-	10年	研究生硕士,具有基金从业资格,曾任职于国金证券研究所、上海从容投资管理有限公司、万家基金管理有限公司。2011年6月加入泰信基金管理有限公司,担任高级研究员,自2011年10月至2014年5月任泰信中小盘精选基金经理助理。2012年4月至2015年1月任泰信优势增长混合基金经理助理。自2015年1月6日起同时兼任泰信中证200指数基金经理。

注:1、以上日期均是指公司公告的日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信中证锐联基本面400指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为,本基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(中国证监会公告[2011]18号),公司制定了《公平交易制度》,适用于所有投资品种,以及所有投资管理活动,涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各环节,从研究、投资、交易合规性监控,发现可疑交易立即报告,并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放,基金经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令,所有投资指令在集中交易室集中执行,投资交易过程公平公正,投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内,投资交易监控与价差分析未发现本基金与其他基金之间存在利益输送行为,公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内,本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易,未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况,亦无其他异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾四季度, A股在经济回暖、险资举牌、地产调控的背景下,指数冲高回落,上证综指上涨3.29%,而创业板则破位下跌8.74%,大盘蓝筹股表现好于中小盘股票。

报告期内,本基金作为被动操作的指数基金,严格执行基金合同规定的投资策略,按照规定的投资策略和方法进行投资操作,努力拟合标的指数,减小跟踪误差,报告期内跟踪误差控制在0.9%。报告期跟踪误差主要是由于基金申购赎回等因素所造成。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金单位净值为0.764元,本季度净值增长率为0.79%,业绩比较基准增长率为1.67%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金有连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	41,414,118.99	93.51
	其中:股票	41,414,118.99	93.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,889,437.62	6.48
8	其他资产	5,739.50	0.01
9	合计	44,289,316.11	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	114,698.56	0.26
B	采矿业	1,778,076.55	4.05
C	制造业	22,079,203.47	50.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,746,283.16	3.97
E	建筑业	1,430,947.53	3.26
F	批发和零售业	3,464,840.42	7.88
G	交通运输、仓储和邮政业	2,560,991.41	5.83
H	住宿和餐饮业	32,258.70	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,460,568.55	3.32
J	金融业	1,769,056.63	4.03
K	房地产业	2,724,828.51	6.20
L	租赁和商务服务业	835,052.46	1.90
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	269,061.06	0.61
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	790,975.95	1.80
S	综合	316,370.03	0.72
	合计	41,363,214.99	94.11

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	50,904.00	0.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	50,904.00	0.12

注:积极投资股票为被动持有非当前成分股,将逐步进行调整成分股。

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有沪港通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000826	金科股份	75,465	395,384.20	0.90
2	000422	湖北宜化	47,700	379,215.00	0.86
3	600729	辽宁成大	15,938	286,246.48	0.65
4	000488	晨鸣纸业	28,953	268,873.08	0.61
5	000623	吉林敦东	8,587	266,111.13	0.61
6	002092	中泰化学	21,404	258,988.40	0.59
7	000423	东阿阿胶	4,678	252,003.86	0.57
8	600143	金发科技	31,900	248,182.00	0.56
9	600655	豫园商城	21,174	241,807.08	0.55
10	600039	四川路桥	47,643	225,827.82	0.51

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601006	重庆钢铁	20,200	50,904.00	0.12

注:积极投资股票为被动持有非当前成分股,将逐步进行调整成分股。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末本基金未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末本基金未投资贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.11.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,229.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	510.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,739.50

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600655	豫园商城	241,807.08	0.55	重大事项

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601006	重庆钢铁	50,904.00	0.12	重大事项

5.11.6 本报告涉及合计数相关比例的,均以合计数除以相关数据计算,而不是对不同比例进行合计。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	泰信基本面400A	泰信基本面400B	泰信基本面400
报告期期初基金份额总额	9,935,189.00	9,935,189.00	33,281,734.27
报告期期间基金总申购份额	-	-	12,578,036.04
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	8,177,581.26
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-3,391,788.00	-3,391,788.00	6,783,576.00
报告期期末基金份额总额	6,543,401.00	6,543,401.00	44,465,765.05

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

泰信基本面400

单位:份

项目	0.00
报告期期间买入/申购总份额	11,611,612.90
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期末管理人持有的本基金份额	11,611,612.90
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	26.11

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位:份

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2016年10月28日	11,611,612.90	8,999,000.00	-
合计			11,611,612.90	8,999,000.00	

注:根据《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金招募说明书》相关约定,本次交易收取固定费用1000元。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金设立的文件

2、《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金基金合同》

3、《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金招募说明书》

4、《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

8.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的办公场所,供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后,投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件或复印件。

8.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)查阅上述相关文件,或拨打客户服务中心电话(400-888-5988,021-38784566),和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司
2017年1月20日

泰信周期回报债券型证券投资基金

【2016】第四季度报告

基金管理人:泰信基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2017年1月20日

§1 重要提示

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中信银行股份有限公司根据基金合同已于2017年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	泰信债券周期回报
交易代码	290009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年2月9日
报告期末基金份额总额	107,463,718.27份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金根据对宏观经济形势、货币和财政政策变化、经济周期及利率走势、企业盈利和信用状况、基金资产流动性情况等因素的动态分析,定期或不定期召开投资决策委员会会议,调整影响资产策略配置的各种因素的变化,战术性配置资产,进行投资时机选择和仓位控制,获取投资收益,降低投资风险。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中证全债指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中风险较低、收益稳定的品种,预期收益和风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	泰信基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	493,120.13
2.本期利润	-1,609,040.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0133
4.期末基金资产净值	120,398,153.12
5.期末基金份额净值	1.120

注:1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关